

日本保険・年金リスク学会（JARIP）第7回大会プログラム

日時：2009年10月24日（土曜日）10：00－17：30（受付開始9：30）

場所：こまばエミナース（最寄り駅：京王井の頭線「駒場東大前」駅）

<http://www.komaba-eminence.com/access.html>

プログラム

- | | |
|-------------|---|
| 10：00－10：30 | 田中 周二 会長講演 |
| 10：30－12：00 | 特別講演 森平 爽一郎（早稲田大学大学院）
「信用リスクモデリングにおけるデフォルト相関」 |
| 12：00－13：30 | 昼食 |
| 13：30－14：30 | 研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場） |
| 14：30－14：45 | 休憩（15分間） |
| 14：45－15：45 | 研究報告Ⅱ（第1会場、第2会場） |
| 15：45－16：00 | 休憩（15分間） |
| 16：00－17：00 | チュートリアル
関村 正悟
「シャドー・バンキング
－サブプライム危機を生み出した米国の金融システム－」 |
| 17：00－17：30 | 総会（第1会場） |
| 17：30－ | 懇親会（1階レストラン「エミナース」） |

* 午前の会場は1階「ダイヤモンド」、午後は第1会場が1階「ダイヤモンド」、第2会場が2階「富士の間」です。

受付は、1階「ダイヤモンド」です。

受付開始 9:30 ~ (1階ダイヤモンドホール)

会長講演および特別講演 (ダイヤモンド)

10:00 - 12:00

座長: 木村 和弘 (日本興亜生命)

「会長講演」

田中 周二 会長 (日本大学)

「信用リスクモデリングにおけるデフォルト相関」

森平 爽一郎 (早稲田大学大学院) 1

研究報告 I

13:30 - 14:30

※研究発表時間: 30分 (質疑応答含む)

第1会場: 1階「ダイヤモンド」、第2会場: 2階「富士の間」

■ 第1会場 年金

座長: 栗山 晃 (朝日生命)

○退職給付会計の国際基準 IAS19 改正のための討議資料の問題点

杉田 健 (中央三井アセット信託)、大森 孝造 (中央三井アセット信託) 50

○確定拠出年金の導入と家計の資産選択の変化

北村 智紀 (ニッセイ基礎研究所)、中嶋 邦夫 (ニッセイ基礎研究所) 65

■ 第2会場 保険

座長: 松山 直樹 (明治大学)

○Surrender Risk and Default Risk of Insurance Companies

Olivier Le Courtois (フランス EM Lyon Business School)、

中川 秀敏 (一橋大学大学院) 80

○重度の新型インフルエンザ・パンデミックが生命保険事業に与える影響

村松 容子 (ニッセイ基礎研究所)、中嶋 邦夫 (ニッセイ基礎研究所) 93

研究報告 II

14:45 - 15:45

※研究発表時間: 30分 (質疑応答含む)

第1会場: 1階「ダイヤモンド」、第2会場: 2階「富士の間」

■ 第1会場 投資・リスク管理

座長: 山内 恒人 (SBI アクサ生命)

○企業年金制度における投資戦略再考

門田 伸一 (筑波大学大学院/野村証券) 105

○生命保険事業における複製ポートフォリオの応用

三石 宣史 (ワトソンワイアット)、森 忠彦 (ワトソンワイアット) 116

■ 第2会場 保険

座長: 伊藤 和平 (三井住友海上)

○支払備金に関する Mack の公式の一般化

斎藤 新悟 (九州大学大学院) 117

○入院リスクに関する一考察

海老崎 美由紀 (日本興亜生命) 125

チュートリアル

16:00-17:00

1階「ダイヤモンド」

座長：木村 和弘（日本興亜損害）

○シャドー・バンキングーサブプライム危機を生み出した米国の金融システムー

関村 正悟（デュエット オルタナティブ インベストメンツ リミテッド）

総会

17:00-17:30

1階「ダイヤモンド」

懇親会

17:30-19:30

1階レストラン「エミナース」

以上